

# PENGARUH REAKSI PASAR TERHADAP HARGA SAHAM PERUSAHAAN LQ 45 DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2016 - 2018

Oleh :

Egi adespan kurniawan

## ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui dan menganalisa pengaruh dari Volume Perdagangan Saham, *abnormal return* dan inflasi terhadap harga saham perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia untuk periode 2016-2018. Sampel dalam penelitian ini berjumlah 45 perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Metode analisis data yang digunakan adalah analisis regresi linear berganda. Berdasarkan hasil penelitian, diketahui bahwa *abnormal return*, Volume Perdagangan Saham dan Inflasi secara simultan mempengaruhi harga saham. Namun secara parsial, *abnormal return* dan inflasi tidak berpengaruh signifikan terhadap harga saham, sedangkan variabel Volume Perdagangan Saham yang dihitung dengan menggunakan *jumlah saham beredar dibagi jumlah saham di perdagangan* berpengaruh signifikan terhadap harga saham perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2016-2018.

**Kata Kunci** : harga saham, *abnormal return*, volume perdagangan saham dan inflasi

## **ABSTRACT**

### ***The Effect Of Market Reaction On The Company's Stock Price Of LQ45 On The Indonesia Stock Exchange In 2016 – 2018***

**By :**

***Egi Adespan Kurniawan***

***1612120221***

*This research was conducted to determine and analyze the effect of Stock Trading Volume, abnormal return and inflation on stock prices of companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the 2016-2018 period. The sample in this study amounted to 45 companies listed on the Indonesia Stock Exchange. The data analysis method used is multiple linear regression analysis. Based on the research results, it is known that abnormal return, share trading volume and inflation simultaneously affect stock prices. However, partially, abnormal returns and inflation do not have a significant effect on stock prices, while the Share Trading Volume variable which is calculated using the price of outstanding shares divided by shares traded has a significant effect on the stock price of companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the period 2016-2018.*

***Keywords:*** *stock price, abnormal return, stock trading volume and inflation*